

リスク・アセットの概要

(平成26年金融庁告示第7号、附則別紙様式第八号第一面)

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要 国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2019年12月末	2019年9月末	2019年12月末	2019年9月末
1	信用リスク	1,930,965	1,872,761	163,465	158,553
2	うち、標準的手法適用分	13,875	8,826	1,110	706
3	うち、内部格付手法適用分	1,857,018	1,803,844	157,549	153,039
	うち、重要な出資のエクスポージャー	-	-	-	-
	うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー	-	-	-	-
	その他	60,071	60,089	4,805	4,807
4	カウンターパーティー信用リスク	44,325	45,672	3,680	3,808
5	うち、SA-CCR適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	11,877	11,010	1,007	933
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	16,043	13,081	1,283	1,046
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	292	279	23	22
	その他	16,111	21,301	1,366	1,806
7	マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	37,509	42,374	3,180	3,593
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(ルックスルー方式)	212,460	216,017	16,885	17,197
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(マナド方式)	17,806	20,403	1,355	1,563
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式250%)	-	-	-	-
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式400%)	-	-	-	-
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(フォールバック方式1250%)	36	36	-	-
11	未決済取引	-	-	-	-
12	信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー	3,615	3,756	289	300
13	うち、内部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-
14	うち、外部格付準拠方式適用分	2,615	2,755	209	220
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	1,000	1,000	80	80
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
16	マーケット・リスク	-	-	-	-
17	うち、標準的方式適用分	-	-	-	-
18	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
19	オペレーショナル・リスク	88,580	88,580	7,086	7,086
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	88,580	88,580	7,086	7,086
22	うち、先進的計測手法適用分	-	-	-	-
23	特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー	8,583	8,583	727	727
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	-	-	-	-
24	フロア調整	-	-	-	-
25	合計	2,343,884	2,298,187	196,671	192,831

(注) 内部格付手法が適用される資産については、リスク・アセットの額はスケールリング・ファクター(1.06)を乗じる前の額を記載し、所要自己資本の額はスケールリング・ファクター(1.06)を乗じて得たリスク・アセットの額に8%を乗じて得た額を記載しております。